

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

شستا را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

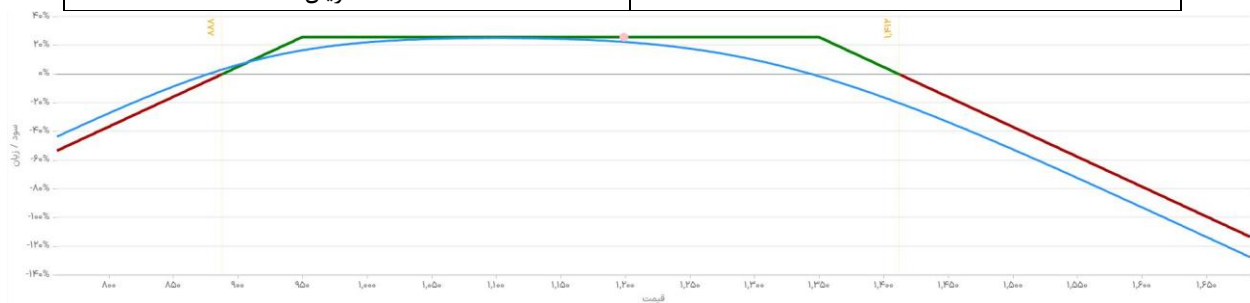
توجه به صعود شارپ این نماد و نزدیک شدن قیمت به ناحیه مقاومتی، احتمال واکنش قیمت و اصلاح کوتاه مدت وجود دارد. بررسی‌ها نشان می‌دهد که احتمال عبور قیمت از ۱۴۱۲ ریال و یافتن قیمت به زیر ۸۸۸ ریال طی ۳۱ روز آینده از احتمال بسیار کمی برخوردار است. به همین جهت استفاده از ابزار اختیار برای کسب سود توصیه می‌شود.

نکات اختیار معامله:

با توجه به این که بازار خنثی بوده و تعیین جهت غیر قابل پیش بینی است، با این استراتژی میتوان از حالت فعلی نوسانات به کسب سود پرداخت. این استراتژی پر ریسک بوده زیرا میزان ضرر مینیمم ندارد و بدیهی است هر چه پرمیم دریافتی بیشتر باشد سود بیشتری کسب خواهد شد. برای اجرای این استراتژی باید ۱ قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و ۱ قرارداد اختیار فروش با قیمتی پایین تر از قیمت بازار فروخت.

۱۰۳۹ ضستا	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۰۳۵ طستا	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۱۰/۱۲	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۵۳ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر
۹ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر

هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۲۵ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۱۴۱۲ ریال
	۸۸۸ ریال



این گزارش صرفاً جنبه تحلیلی دارد و هیچگونه سیگنال خرید و یا فروش نمیباشد. (سلب مسئولیت)

تحلیل گر: شریف بخش